Principal Asset Management℠

Principal Claritas

CLARITAS INFLAÇÃO INSTITUCIONAL

Fevereiro de 2024

Informações Gerais

Data de Início	05/10/2011
Taxa de Administração[2]	1,00% a.a.
Taxa de Performance	20%a.a. sobre o que exceder 100% da variação do IMA-B 5
Aplicação | Cotização	D+0 (fechamento)
Aplicação | Liquidação	D+0 (fechamento)
Resgate | Cotização	D+0 (fechamento)
Resgate | Liquidação	D+1 (1º d.u. após a data de cotização)
Taxa de Saída	Não se aplica
Horário de movimentação[4]	Solicitação até às 14:30h
Aplicação inicial	R$ 1.000,00 (mil reais)
Movimentação Mínima	R$ 1,00 (um real)
Saldo Mínimo	R$ 1.000,00 (mil reais)
Conta para Aplicação	BTG Pactual S.A. - nº 208 Agência: 0001 | Conta Corrente: 3911665 Favorecido: Claritas Inflação Institucional FIM CNPJ: 13.176.277/0001-11
Classificação ANBIMA	Multimercados Macro
Código ANBIMA	288561
Bloomberg	CLRTASI BZ
ISIN	BRCLV3CTF006
CNPJ	13.176.277/0001-11
Tributação[5]	Longo Prazo

Dados

Valor da cota em 29/02/2024		3,5181263
Patrimônio Líquido	R$	20.474.458,47
PL Médio 12 meses[1]	R$	22.398.260,81

Informações Adicionais

Gestor	Claritas Administração de Recursos LTDA.
Administrador	BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM
Custodiante	Banco BTG Pactual S.A.

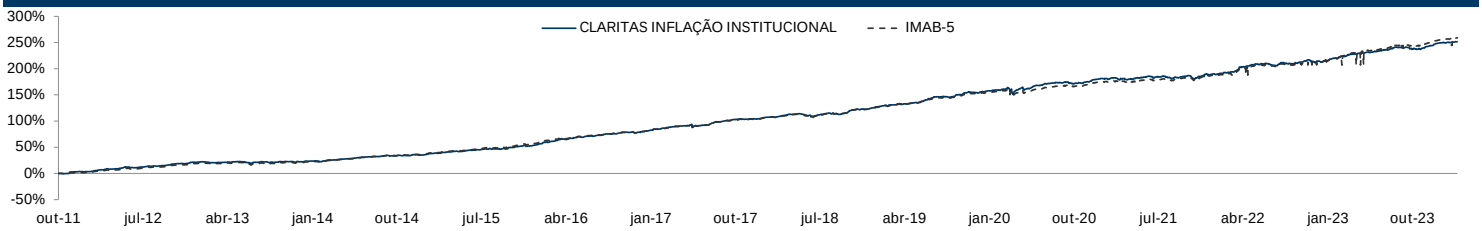
Objetivos do Fundo e Política de Investimento

O FUNDO tem como objetivo obter ganhos de capital através de operações nos mercados de juros, câmbio, ações, commodities e dívida, utilizando-se dos instrumentos disponíveis tanto nos mercados à vista quanto nos mercados de derivativos, atuando a partir de estratégias de investimento baseadas em cenários macroeconômicos de médio e longo prazos. O FUNDO poderá aplicar seus recursos em qualquer ativo financeiro permitido pela regulamentação em vigor e por seu Regulamento, bem como em ativos financeiros negociados no exterior, desde que tenham a mesma natureza econômica de tais ativos.

Público Alvo

O FUNDO tem como público alvo investidores em geral que tenham horizonte de investimento de médio e longo prazo e que buscam retornos superiores ao IMAB 5, participando das oportunidades no mercado. Deve-se observar, no que couber, as vedações aplicadas às entidades fechadas de previdência complementar ("EFPC") previstas na Resolução do CMN nº 4.994/22 (EFPC) e na Resolução nº 4.963/21, aplicada aos recursos dos Regimes Próprios de Previdência Complementar instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios ("RPPS").

Rentabilidade



Retornos mensais

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Desde Inicio
2011	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,11%	3,52%	-0,06%	3,34%	3,34%
	IMAB-5	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,68%	1,41%	0,14%	1,79%	1,79%
2012	Fundo	1,92%	1,71%	1,16%	1,97%	0,81%	0,74%	1,35%	0,78%	1,58%	2,03%	0,83%	1,42%	17,56%	21,49%
	IMAB-5	1,85%	1,46%	1,12%	1,71%	0,70%	0,79%	1,67%	0,63%	1,65%	1,81%	1,01%	1,39%	16,98%	19,08%
2013	Fundo	-0,09%	-0,59%	0,53%	0,83%	-1,13%	0,11%	0,83%	-0,80%	1,00%	0,32%	-0,23%	1,10%	1,85%	23,74%
	IMAB-5	0,23%	-0,50%	0,66%	0,92%	-1,19%	-0,63%	0,87%	-0,44%	1,21%	0,49%	-0,01%	1,17%	2,78%	22,39%
2014	Fundo	-1,10%	2,70%	0,73%	1,26%	1,50%	0,94%	0,82%	1,36%	-0,59%	0,70%	1,19%	-0,36%	9,46%	35,45%
	IMAB-5	-0,79%	2,87%	0,90%	1,32%	1,47%	1,11%	0,86%	1,35%	0,00%	0,94%	1,05%	0,04%	11,64%	36,63%
2015	Fundo	2,14%	1,06%	1,07%	0,43%	1,79%	0,41%	1,85%	-0,63%	0,97%	2,04%	0,40%	1,86%	14,20%	54,68%
	IMAB-5	2,05%	1,22%	1,03%	0,46%	1,63%	0,85%	1,78%	-0,47%	0,79%	2,49%	0,55%	2,12%	15,46%	57,75%
2016	Fundo	3,06%	1,44%	1,90%	2,06%	0,55%	1,04%	1,41%	1,07%	1,54%	0,41%	0,45%	1,41%	17,58%	81,87%
	IMAB-5	2,97%	1,54%	0,76%	1,54%	0,80%	0,94%	1,21%	1,09%	1,41%	0,46%	0,40%	1,39%	15,48%	82,18%
2017	Fundo	1,36%	1,70%	1,31%	0,62%	0,22%	0,46%	2,88%	1,27%	1,17%	0,45%	0,03%	0,85%	12,99%	105,50%
	IMAB-5	1,16%	1,49%	1,39%	0,71%	0,08%	0,52%	2,85%	1,25%	1,01%	0,48%	0,10%	0,88%	12,58%	105,09%
2018	Fundo	1,28%	0,61%	1,76%	0,40%	-1,58%	0,43%	1,49%	-0,50%	0,81%	3,22%	0,16%	1,53%	9,97%	125,98%
	IMAB-5	1,33%	0,54%	1,62%	0,42%	-1,56%	0,45%	1,48%	-0,26%	0,89%	3,10%	0,14%	1,36%	9,87%	125,32%
2019	Fundo	1,91%	0,20%	0,63%	0,85%	1,43%	2,38%	1,10%	-0,07%	1,93%	1,88%	-0,52%	1,53%	14,05%	157,73%
	IMAB-5	1,54%	0,55%	0,78%	1,11%	1,39%	1,72%	0,97%	0,05%	1,74%	1,65%	-0,28%	1,24%	13,15%	154,96%
2020	Fundo	0,53%	0,69%	-0,84%	0,83%	2,33%	1,23%	0,97%	0,14%	-0,52%	0,11%	1,51%	1,89%	9,19%	181,41%
	IMAB-5	0,56%	0,64%	-1,75%	0,49%	2,12%	1,12%	0,99%	0,43%	-0,12%	0,20%	1,32%	1,83%	8,04%	175,46%
2021	Fundo	-0,15%	-0,67%	0,35%	0,92%	0,80%	-0,20%	-0,10%	-0,23%	0,65%	-1,51%	2,31%	0,98%	3,13%	190,22%
	IMAB-5	0,11%	-0,60%	0,34%	0,87%	0,69%	-0,13%	0,03%	0,15%	1,00%	-1,24%	2,50%	-1,63%	2,06%	181,14%
2022	Fundo	0,15%	1,06%	2,84%	1,53%	0,58%	0,15%	-0,15%	0,26%	0,61%	1,80%	-0,73%	0,71%	9,11%	216,67%
	IMAB-5	0,11%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	0,00%	0,42%	1,91%	-0,33%	0,94%	9,78%	216,21%
2023	Fundo	1,07%	1,18%	1,15%	0,61%	0,66%	1,18%	0,87%	0,32%	-0,16%	-0,67%	2,06%	1,57%	10,25%	249,11%
	IMAB-5	1,40%	1,41%	1,52%	0,90%	0,57%	1,05%	0,97%	0,61%	0,13%	-0,31%	1,80%	1,46%	12,13%	254,55%
2024	Fundo	0,39%	0,38%											0,77%	251,81%
	IMAB-5	0,68%	0,59%											1,28%	259,08%

Estatísticas

	% Acum.	IMAB-5 %
Últimos 12 meses	8,65	10,44
Últimos 24 meses	19,78	23,21
Últimos 36 meses	26,05	31
Desde o início	251,81	259,08
Retorno médio mensal (desde o início)[3]	0,86%	
Volatilidade diária anualizada (12 meses)	2,21%	

Meses positivos	122
Meses negativos	27
Meses acima do benchmark	66
Meses abaixo do benchmark	83
Maior retorno mensal	3,52%
Menor retorno mensal	-1,58%

Gestora

Principal Claritas
Av. Brigadeiro Faria Lima, 4221 | 4° andar
04538-133 | São Paulo - São Paulo
t + 55 11 2131 4900 | f + 55 11 2131 4930
www.claritas.com.br | claritas@claritas.com.br

Autorregulação ANBIMA
Gestão de Recursos

Administrador

BTG Pactual Serviços Financeiros (CNPJ: 59.281.253/0001-23)
Praia de Botafogo, n.º 501, 5º andar, Rio de Janeiro, RJ - CEP 22250-040
Telefone: (21) 3262-9600
www.btgpactual.com
SAC: sac@btgpactual.com ou 0800 772 28 27
Ouvidoria: ouvidoria@btgpactual.com

[1]Valor da média aritmética da soma do patrimônio líquido apurado no último dia útil de cada mês, nos 12 (doze) meses anteriores. [2]A taxa de administração prevista no caput é a taxa de administração mínima do FUNDO. Tendo em vista que o FUNDO admite a aplicação em cotas de fundos de investimento, fica instituída a taxa de administração máxima de 2% a.a. sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO. [3]Média da rentabilidade mensal desde o início do fundo. A divulgação do CDI tem caráter de mera referência econômica, e não se caracteriza como meta ou parâmetro de performance do Fundo de investimento. [4]O horário limite de liquidação é 17h30 para TED e CETIP. O horário de entrada das teds para aplicação é 15h. Em 21/03/2022, o fundo teve sua administração fiduciária migrada da BNY Mellon DTVM para o BTG Pactual DTVM. [5]Não há obrigação de que este fundo siga o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Utiliza-se como metodologia para o cálculo de rentabilidade, as últimas cotas dos meses de referência dos períodos. Os fundos multimercados com renda variável podem estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Leia o formulário de informações complementares, a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Tais documentos encontram-se disponíveis no site do administrador (https://www.btgpactual.com/asset-management/administracao-fiduciaria/busca-por-fundos/). A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e taxa de saída. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito – FGC. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O fundo pode utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento; tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo dos fundos. As informações contidas nesse material são de caráter exclusivamente informativo. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. A Claritas Administração de Recursos Ltda ("Principal Claritas") não se responsabiliza por ganhos ou perdas consequentes do uso deste informativo. Este material não pode ser copiado, reproduzido ou distribuído sem a prévia e expressa concordância da Principal Claritas. Principal Asset ManagementSM é o nome comercial para Principal Global Investors, LLC, membro do Principal Financial Group. Principal Claritas é o nome comercial para Claritas Administracao de Recursos Ltda., uma filiada da Principal Global Investors.